

首创证券创赢 25 号集合资产管理计划变更合同条款说明十一

《首创证券创赢 25 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“原合同”)中条款更改主要涉及以下内容:

一、原合同“四、当事人及权利义务”部分,

原:

1、托管人简况

名称:广发银行股份有限公司

地址:北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦

法定代表人或负责人:王凯

邮政邮编:100731

业务联系人:李萌

联系电话:010-65169086

传真:010-65169555

变更为:

1、托管人简况

名称:广发银行股份有限公司

地址:北京市西城区金融大街 15 号鑫茂大厦北楼

法定代表人或负责人:王凯

邮政邮编:100731

业务联系人:卢晓晨

联系电话:010-65169644

传真:010-65169555

二、原合同“五、资产管理计划的基本情况”中“2、主要投资方向”部分,

原:

(1) 固定收益类资产:包括国债、地方政府债、央行票据、金融债(含政策性银行债)、二级资本债、次级债、永续债、同业存单、企业债、公司债(含非公开发行的公司债,下同)、优先级资产支持证券(含证监会和其他金融监督

管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。

变更为：

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。

三、原合同“五、资产管理计划的基本情况”中“3、投资比例”部分，

新增：

本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算；本资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

四、原合同“六、资产管理计划的募集”中“（一）资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限”部分，

原：

1、募集对象

本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者总计不得超过 200 人。委托人应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

（1）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。依法设立并受监管的各类投资产品视为单一合格投资者。

变更为：

1、募集对象

本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者总计不得超过 200 人。委托人应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会



公募基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

（6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。依法设立并受监管的各类投资产品视为单一合格投资者。

投资者仅能以其合法所有的自有资金（即不包括以管理人、受托人或类似的身份合法管理的募集资金，下同）认购/申购本资产管理计划。

五、原合同“十一、资产管理计划的投资”中“1、投资范围”部分，

原：

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、永续债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。

变更为：

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。

六、原合同“十一、资产管理计划的投资”中“2、资产配置比例及限制”部分，

新增：

本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算；本资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

七、原合同“二十一、资产管理计划的收益分配”中“（四）收益分配方案的确定、通知和实施”部分，

原：

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人告知委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。管理人应在收益分配日根据收益分配方案实施收益分配。

变更为：

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人报告委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。管理人应在收益分配日根据收益分配方案实施收益分配。

八、原合同“附件 2：交易监控合规表”部分，

变更为：

序号	项目	监控内容
1	监控范围	本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。 （1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、同业存单、企业债、公司债（含公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。 投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA。（不含中债资信、穆迪评级） （2）现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购。 （3）金融产品类资产（不包括货币市场基金）：包括人民币形式的银行非保本理财产品，信托计划，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基

		金管理子公司、商业银行理财子公司、期货公司、期货公司子公司、保险公司及保险资管公司发行的资管产品，于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金； 本集合计划投资的金融产品，其投资标的中不应包含除公募基金之外的其他资产管理产品。 (4) 期货和衍生品类资产：国债期货。 (5) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。
2	监控比例及限制	(1) 穿透来看，本集合计划投资于固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。 (2) 债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。 (3) 债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。 (4) 本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的 200%。本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。 (5) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。 (6) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的 25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的 25%；本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。 (7) 本集合计划穿透后不得投资非标准化资产。 (8) 本集合计划投资于期货和衍生品类（仅投资期货保证金）资产占本集合计划资产总值的 0%-20%（不含），不进行期货和衍生品交易。 主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

上述变更内容如涉及到托管协议、计划说明书、风险揭示书，相应同步变更。

